Fecha de Publicación: 12 de junio de 2018

Fecha de Información: 07 de junio de 2018 [1]

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US$1932.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.[2]

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	315.8	316.1	91.0	101.1	76.1	65.7	149.0
15-35	491.6	625.7	334.2	146.8	25.9	79.2	265.7
36-60	193.4	139.2	0.0	0.0	99.2	153.4	40.0
61-90	1.1	3.0	0.0	0.0	3.0	1.1	0.0
91-180	127.1	103.5	45.0	0.0	28.5	97.1	30.0
>180	58.8	81.3	35.0	15.0	6.3	3.8	40.0
Total	**1187.9**	**1268.9**	**505.2**	**262.9**	**239.0**	**400.3**	**524.7**

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.3 %	1.4 %	1.1 %	1.2 %
15-35	1.3 %	1.4 %	1.3 %	1.3 %
36-60	1.3 %	1.4 %	1.3 %	1.3 %
61-90	-	2.2 %	1.2 %	2.0 %
91-180	1.4 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
>180	1.7 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
Total	1.3 %	1.4 %	1.3 %	1.3 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	4 al 8 de junio				11 al 15 de junio				18 al 22 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	38	124	4124	4205	56	141	4316	4435	47	115	4888	4742
Intragrupo y off-shore***	0	0	1844	1713	0	0	1460	921	0	0	1791	1536
Otros	124	38	1045	1095	131	46	1485	1905	105	37	1514	1915
Total	**161**	**161**	**7013**	**7013**	**186**	**186**	**7261**	**7261**	**152**	**152**	**8193**	**8193**

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

[1] Datos provisionales.

[2] El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.